

ALLIANZ YAŐAM VE EMEKLİLİK A.Ő.
KOÇ İŐTİRAK ENDEKSİ EMEKLİLİK YATIRIM FONU

31 ARALIK 2017 TARİHİ İTİBARIYLA
PAY FİYATININ HESAPLANMASINA DAYANAK
TEŐKİL EDEN PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU VE
TOPLAM DEĞER/NET VARLIK DEĞERİ TABLOSUNU
İÇEREN FİYAT RAPORLARININ MEVZUATA UYGUN
OLARAK HAZIRLANMASINA İLİŐKİN RAPOR



**ALLIANZ YAŞAM VE EMEKLİLİK A.Ş.
KOÇ İŞTİRAK ENDEKSİ EMEKLİLİK YATIRIM FONU**

**PAY FİYATININ HAZIRLANMASINA DAYANAK TEŞKİL EDEN PORTFÖY DEĞERİ
TABLOSU VE TOPLAM DEĞER/NET VARLIK DEĞERİ TABLOSUNU İÇEREN FİYAT
RAPORLARININ MEVZUATA UYGUN OLARAK HAZIRLANMASINA İLİŞKİN RAPOR**

Allianz Yaşam ve Emeklilik A.Ş. Koç İştirak Endeksi Emeklilik Yatırım Fonu'nun ("Fon") Pay Fiyatının Hazırlanmasına Dayanak Teşkil Eden Portföy Değeri Tablosu ve Toplam Değer/Net Varlık Değeri Tablosunu İçeren Fiyat Raporlarınının 30 Aralık 2013 tarihli ve 28867 (Mükerrer) sayılı Resmi Gazete'de yayımlanan "Yatırım Fonlarının Finansal Raporlama Standartlarına İlişkin Tebliğ (II-14.2)" hükümlerine ve Sermaye Piyasası Kurulu'nca belirlenen esaslara uygun olarak hazırlanıp hazırlanmadığını Sermaye Piyasası Kurulu'nun konu hakkındaki düzenleme ve duyuruları çerçevesinde 31 Aralık 2017 tarihi itibarıyla incelemiş bulunuyoruz.

Allianz Yaşam ve Emeklilik A.Ş. Koç İştirak Endeksi Emeklilik Yatırım Fonu'nun Pay Fiyatının Hazırlanmasına Dayanak Teşkil Eden Portföy Değeri Tablosu ve Toplam Değer/Net Varlık Değeri Tablosunu İçeren Fiyat Raporları 30 Aralık 2013 tarihli ve 28867 (Mükerrer) sayılı Resmi Gazete'de yayımlanan "Yatırım Fonlarının Finansal Raporlama Standartlarına İlişkin Tebliğ (II-14.2)" hükümlerine ve Sermaye Piyasası Kurulu'nca belirlenen esaslara uygun olarak hazırlanmıştır.

Bu rapor tamamen Sermaye Piyasası Kurulu ve Fon Kurulu ile Allianz Yaşam ve Emeklilik A.Ş.'nin bilgisi ve kullanımı için hazırlanmış olup, başka bir maksatla kullanılması mümkün değildir.

PwC Bağımsız Denetim ve
Serbest Muhasebeci Mali Müşavirlik A.Ş.


Talar Gül, SMMM
Sorumlu Denetçi

İstanbul, 30 Mart 2018

ALLIANZ YAŞAM VE EMEKLİLİK A.Ş.
KOÇ İŞTİRAK ENDEKSİ EMEKLİLİK YATIRIM FONU

31 ARALIK 2017 TARİHLİ TOPLAM FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU

(Tüm tutarlar, Türk Lirası ("TL") olarak gösterilmiştir.)

Menkul Kıymet	İhraççı	Vade	ISIN Kodu	Menkul Tanım	Normal Faiz Oran	Faiz Öde. Sayı	Nominal Değ./Kontrat Sayısı	Birim Alış Fiyatı	Satın Alın Tarihi	İskon. Oran	Borsa Sözl. No	Repo Teminat Tutarı	Günlük Birim Değer	Günlük Kur	Toplam Değer	Grup %	Toplam %	Toplam %	DEP	DEP	
A.PAY																					
	AKBNK		TRAAKBNK91N6	AKBNK			675.000.000	9,219073	26/12/2017				9,85		6.648.750,00	1,85%	1,69%	1,67%	SRB	0	
	AKSA ENERJİ		TREAKSN00011	AKSEN			500.000.000	3,889055	19/12/2017				4,13		2.065.000,00	0,57%	0,52%	0,52%	SRB	0	
	ARÇELİK		TRAAARCL91H5	ARCLK			1.675.000.000	19,543791	17/11/2017				21,52		16.046.000,00	10,03%	9,14%	9,08%	SRB	0	
	AYGAZ		TRAAAYGAZ91E0	AYGAZ			2.275.000.000	11,633079	21/11/2017				16,07		16.559.250,00	10,17%	9,27%	9,21%	SRB	0	
	CELEBİ		TRACLEBB91M5	CLEBI			15.000.000	33,470652	13/12/2017				36,98		554.700,00	0,15%	0,14%	0,14%	SRB	0	
	FORD OTOSAN Türkiye Garanti Bankası		TRAOTOSN91H6	FROTO			450.000.000	32,918962	10/07/2017				60,25		17.112.500,00	7,54%	6,88%	6,83%	SRB	0	
	HÜRRİYET GZT.		TRAHURGZ91D9	HURGZ			2.250.000.000	1,271822	28/12/2017				10,72		4.020.000,00	1,12%	1,02%	1,01%	SRB	0	
	İŞ GMYO		TRAIISGYO91Q3	ISGYO			0,5500	1,374545	21/12/2017				1,34		3.015.000,00	0,84%	0,76%	0,76%	SRB	0	
	KOÇ HOLDİNG ODAS ELEKTRİK		TRAKCHOL91Q8	KCHOL			2.100.000.950	14,596583	30/10/2017				1,36	0,75	0,00%	0,00%	0,00%	SRB	0		
	OTOKAR		TREODAS00014	ODAS			800.000.000	5,519967	18/12/2017				18,48		18.808.017,56	10,80%	9,84%	9,77%	SRB	0	
	OTOKAR		TRAOTKAR91H3	OTKAR			280.000.000	98,976901	16/10/2017				6		4.800.000,00	1,34%	1,22%	1,21%	SRB	0	
	OTOKAR		TRAOTKAR91H3	OTKAR			1.000	122,5	29/12/2017		604A0282009D38AA		123,8		123,8	0,00%	0,00%	0,00%	SRB	0	
	OTOKAR		TRAOTKAR91H3	OTKAR			2.000	122,5	29/12/2017		604A0282009D38AA		123,8		247,6	0,00%	0,00%	0,00%	SRB	0	
	OTOKAR		TRAOTKAR91H3	OTKAR			2.000	122,5	29/12/2017		604A0282009D38AA		123,8		247,6	0,00%	0,00%	0,00%	SRB	0	
	OTOKAR		TRAOTKAR91H3	OTKAR			2.000	122,5	29/12/2017		604A0282009D38AA		123,8		247,6	0,00%	0,00%	0,00%	SRB	0	
	OTOKAR		TRAOTKAR91H3	OTKAR			49.000	122,5	29/12/2017		604A0282009D38AA		123,8		6.066,20	0,00%	0,00%	0,00%	SRB	0	
	OTOKAR		TRAOTKAR91H3	OTKAR			80.000	122,5	29/12/2017		604A0282009D38AA		123,8		9.904,00	0,00%	0,00%	0,00%	SRB	0	
	OTOKAR		TRAOTKAR91H3	OTKAR			80.000	122,5	29/12/2017		604A0282009D38AA		123,8		9.904,00	0,00%	0,00%	0,00%	SRB	0	
	OTOKAR		TRAOTKAR91H3	OTKAR			100.000	122,5	29/12/2017		604A0282009D38AA		123,8		12.380,00	0,00%	0,00%	0,00%	SRB	0	
	OTOKAR		TRAOTKAR91H3	OTKAR			100.000	122,5	29/12/2017		604A0282009D38AA		123,8		12.380,00	0,00%	0,00%	0,00%	SRB	0	
	OTOKAR		TRAOTKAR91H3	OTKAR			104.000	122,5	29/12/2017		604A0282009D38AA		123,8		12.875,20	0,00%	0,00%	0,00%	SRB	0	
	OTOKAR		TRAOTKAR91H3	OTKAR			150.000	122,5	29/12/2017		604A0282009D38AA		123,8		18.570,00	0,01%	0,00%	0,00%	SRB	0	
	OTOKAR		TRAOTKAR91H3	OTKAR			299.000	122,5	29/12/2017		604A0282009D38AA		123,8		37.016,20	0,01%	0,01%	0,01%	SRB	0	
	OTOKAR		TRAOTKAR91H3	OTKAR			939.000	122,5	29/12/2017		604A0282009D38AA		123,8		116.248,20	0,03%	0,03%	0,03%	SRB	0	
	OTOKAR		TRAOTKAR91H3	OTKAR			1.000.000	122,5	29/12/2017		604A0282009D38AA		123,8		123.800,00	0,03%	0,03%	0,03%	SRB	0	
	OTOKAR		TRAOTKAR91H3	OTKAR			2.173.000	122,4	29/12/2017		604A0282009D38AA		123,8		269.017,40	0,07%	0,07%	0,07%	SRB	0	
	OTOKAR		TRAOTKAR91H3	OTKAR			2.419.000	122,5	29/12/2017		604A0282009D38AA		123,8		299.472,20	0,08%	0,08%	0,08%	SRB	0	
Ara Toplam							287.500.000								35.592.500,00	9,90%	9,93%	9,96%	SRB	0	
	SİSE CAM		TRASISEW91Q3	SISE			0,0780	4,384615	14/12/2017				4,7		0,37	0,00%	0,00%	0,00%	SRB	0	
	SODA SANA YH		TRASODAS91E5	SODA			175.000.000	5,005714	26/12/2017				5,04		882.000,00	0,25%	0,22%	0,22%	SRB	0	
	TAT GIDA		TRATATKS91A5	TATGD			4.775.000.000	5,466039	09/11/2017				5,31		25.355.250,00	7,06%	6,43%	6,38%	SRB	0	
	TOFAŞ OTO. FAB.		TRATOASO91H3	TOASO			950.000.000	19,451381	04/08/2017				33,02		31.369.000,00	8,73%	7,95%	7,90%	SRB	0	
	TRAKYA CAM		TRATRKKM91F7	TRKCM			375.000.000	4,481333	28/12/2017				4,62		1.732.500,00	0,48%	0,44%	0,44%	SRB	0	
	TRAKYA CAM		TRATRKKM91F7	TRKCM			407.000	4,54	29/12/2017		604A0282009F32D2		4,62		1.880,34	0,00%	0,00%	0,00%	SRB	0	
	TRAKYA CAM		TRATRKKM91F7	TRKCM			450.000	4,52	29/12/2017		604A0282009F32D2		4,62		2.079,00	0,00%	0,00%	0,00%	SRB	0	
	TRAKYA CAM		TRATRKKM91F7	TRKCM			655.000	4,54	29/12/2017		604A0282009F32D2		4,62		3.026,10	0,00%	0,00%	0,00%	SRB	0	
	TRAKYA CAM		TRATRKKM91F7	TRKCM			750.000	4,52	29/12/2017		604A0282009F32D2		4,62		3.465,00	0,00%	0,00%	0,00%	SRB	0	
	TRAKYA CAM		TRATRKKM91F7	TRKCM			1.000.000	4,54	29/12/2017		604A0282009F32D2		4,62		4.620,00	0,00%	0,00%	0,00%	SRB	0	
	TRAKYA CAM		TRATRKKM91F7	TRKCM			1.000.000	4,58	29/12/2017		604A028201192A27		4,62		4.620,00	0,00%	0,00%	0,00%	SRB	0	
	TRAKYA CAM		TRATRKKM91F7	TRKCM			1.305.000	4,58	29/12/2017		604A028201192A27		4,62		6.029,10	0,00%	0,00%	0,00%	SRB	0	
	TRAKYA CAM		TRATRKKM91F7	TRKCM			1.346.000	4,56	29/12/2017		604A0282010FFD8A		4,62		6.218,52	0,00%	0,00%	0,00%	SRB	0	
	TRAKYA CAM		TRATRKKM91F7	TRKCM			1.573.000	4,54	29/12/2017		604A0282009F32D2		4,62		7.267,26	0,00%	0,00%	0,00%	SRB	0	
	TRAKYA CAM		TRATRKKM91F7	TRKCM			1.875.000	4,54	29/12/2017		604A0282009F32D2		4,62		8.662,50	0,00%	0,00%	0,00%	SRB	0	
	TRAKYA CAM		TRATRKKM91F7	TRKCM			1.937.000	4,54	29/12/2017		604A0282009F32D2		4,62		8.948,94	0,00%	0,00%	0,00%	SRB	0	
	TRAKYA CAM		TRATRKKM91F7	TRKCM			2.171.000	4,54	29/12/2017		604A0282009F32D2		4,62		10.030,02	0,00%	0,00%	0,00%	SRB	0	
	TRAKYA CAM		TRATRKKM91F7	TRKCM			3.454.000	4,56	29/12/2017		604A0282010FF7ADA		4,62		15.957,48	0,00%	0,00%	0,00%	SRB	0	
	TRAKYA CAM		TRATRKKM91F7	TRKCM			4.924.000	4,54	29/12/2017		604A0282009F32D2		4,62		22.748,88	0,01%	0,01%	0,01%	SRB	0	
	TRAKYA CAM		TRATRKKM91F7	TRKCM			5.000.000	4,56	29/12/2017		604A0282010FF7ADA		4,62		23.100,00	0,01%	0,01%	0,01%	SRB	0	
	TRAKYA CAM		TRATRKKM91F7	TRKCM			5.000.000	4,58	29/12/2017		604A028201192A27		4,62		23.100,00	0,01%	0,01%	0,01%	SRB	0	
	TRAKYA CAM		TRATRKKM91F7	TRKCM			7.575.000	4,52	29/12/2017		604A028201192A27		4,62		34.996,50	0,01%	0,01%	0,01%	SRB	0	
	TRAKYA CAM		TRATRKKM91F7	TRKCM			7.859.000	4,52	29/12/2017		604A028201192A27		4,62		36.308,58	0,01%	0,01%	0,01%	SRB	0	
	TRAKYA CAM		TRATRKKM91F7	TRKCM			15.161.000	4,54	29/12/2017		604A0282009F32D2		4,62		70.043,82	0,02%	0,02%	0,02%	SRB	0	
	TRAKYA CAM		TRATRKKM91F7	TRKCM			16.136.000	4,56	29/12/2017		604A0282010FF7ADA		4,62		74.548,32	0,02%	0,02%	0,02%	SRB	0	
	TRAKYA CAM		TRATRKKM91F7	TRKCM			20.000.000	4,54	29/12/2017		604A0282009F32D2		4,62		92.400,00	0,03%	0,02%	0,02%	SRB	0	
	TRAKYA CAM		TRATRKKM91F7	TRKCM			20.911.000	4,5	29/12/2017		604A0282009F32D2		4,62		96.608,82	0,03%	0,02%	0,02%	SRB	0	
	TRAKYA CAM		TRATRKKM91F7	TRKCM			25.000.000	4,56	29/12/2017		604A0282010B93AB		4,62		115.500,00	0,03%	0,03%	0,03%	SRB	0	

ALLIANZ YAŞAM VE EMEKLİLİK A.Ş.
KOÇ İŞTİRAK ENDEKSİ EMEKLİLİK YATIRIM FONU

31 ARALIK 2017 TARİHLİ TOPLAM FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU

(Tüm tutarlar, Türk Lirası ("TL") olarak gösterilmiştir.)

Menkul Kıymet	İhraççı	Vade	ISIN Kodu	Menkul Tanımı	Normal Faiz Oran	Faiz Öde. Sayı	Nominal Değ./Kontrat Sayısı	Birim Alış Fiyatı	Satın Alın Tarihi	İskon Oran	Borsa Söze. No	Repo Teminat Tutarı	Günlük Birim Değer	Günlük Kur	Toplam Değer	Grup %	Toplam %	Toplam %	DEP	DEP
	TRAKYA CAM		TRTRKCM91F7	TRKCM			36.960.000	4,58	29/12/2017		604A028201192A27		4,62		170.755,20	0,05%	0,04%	0,04%	SRB	0
	TRAKYA CAM		TRTRKCM91F7	TRKCM			59.704.000	4,57	29/12/2017		604A028201170A1A		4,62		275.832,48	0,08%	0,07%	0,07%	SRB	0
	TRAKYA CAM		TRTRKCM91F7	TRKCM			68.389.000	4,52	29/12/2017				4,62		315.957,18	0,09%	0,08%	0,08%	SRB	0
	TRAKYA CAM	10.000	TRTRKCM91F7	TRKCM			4.000	4,54	29/12/2017		604A0282009F040D		4,62		46,2	0,00%	0,00%	0,00%	SRB	0
	TRAKYA CAM	8.000	TRTRKCM91F7	TRKCM			4.000	4,52	29/12/2017				4,62		18,48	0,00%	0,00%	0,00%	SRB	0
	TRAKYA CAM	10.000	TRTRKCM91F7	TRKCM			10.000	4,52	29/12/2017				4,62		46,2	0,00%	0,00%	0,00%	SRB	0
	TRAKYA CAM	10.000	TRTRKCM91F7	TRKCM			10.000	4,52	29/12/2017				4,62		46,2	0,00%	0,00%	0,00%	SRB	0
	TRAKYA CAM	10.000	TRTRKCM91F7	TRKCM			10.000	4,52	29/12/2017				4,62		46,2	0,00%	0,00%	0,00%	SRB	0
	TRAKYA CAM	10.000	TRTRKCM91F7	TRKCM			10.000	4,52	29/12/2017				4,62		46,2	0,00%	0,00%	0,00%	SRB	0
	TRAKYA CAM	10.000	TRTRKCM91F7	TRKCM			10.000	4,52	29/12/2017				4,62		46,2	0,00%	0,00%	0,00%	SRB	0
	TRAKYA CAM	10.000	TRTRKCM91F7	TRKCM			10.000	4,52	29/12/2017				4,62		46,2	0,00%	0,00%	0,00%	SRB	0
	TRAKYA CAM	10.000	TRTRKCM91F7	TRKCM			10.000	4,52	29/12/2017				4,62		46,2	0,00%	0,00%	0,00%	SRB	0
	TRAKYA CAM	10.000	TRTRKCM91F7	TRKCM			10.000	4,52	29/12/2017				4,62		46,2	0,00%	0,00%	0,00%	SRB	0
	TRAKYA CAM	10.000	TRTRKCM91F7	TRKCM			10.000	4,52	29/12/2017				4,62		46,2	0,00%	0,00%	0,00%	SRB	0
	TRAKYA CAM	10.000	TRTRKCM91F7	TRKCM			10.000	4,52	29/12/2017				4,62		46,2	0,00%	0,00%	0,00%	SRB	0
	TRAKYA CAM	10.000	TRTRKCM91F7	TRKCM			10.000	4,52	29/12/2017				4,62		46,2	0,00%	0,00%	0,00%	SRB	0
	TRAKYA CAM	10.000	TRTRKCM91F7	TRKCM			10.000	4,52	29/12/2017				4,62		46,2	0,00%	0,00%	0,00%	SRB	0
	TRAKYA CAM	10.000	TRTRKCM91F7	TRKCM			10.000	4,52	29/12/2017				4,62		46,2	0,00%	0,00%	0,00%	SRB	0
	TRAKYA CAM	10.000	TRTRKCM91F7	TRKCM			10.000	4,52	29/12/2017				4,62		46,2	0,00%	0,00%	0,00%	SRB	0
	TRAKYA CAM	10.000	TRTRKCM91F7	TRKCM			10.000	4,52	29/12/2017				4,62		46,2	0,00%	0,00%	0,00%	SRB	0
	TRAKYA CAM	10.000	TRTRKCM91F7	TRKCM			10.000	4,52	29/12/2017				4,62		46,2	0,00%	0,00%	0,00%	SRB	0
	TRAKYA CAM	10.000	TRTRKCM91F7	TRKCM			10.000	4,52	29/12/2017				4,62		46,2	0,00%	0,00%	0,00%	SRB	0
	TRAKYA CAM	10.000	TRTRKCM91F7	TRKCM			10.000	4,52	29/12/2017				4,62		46,2	0,00%	0,00%	0,00%	SRB	0
	TRAKYA CAM	10.000	TRTRKCM91F7	TRKCM			10.000	4,52	29/12/2017				4,62		46,2	0,00%	0,00%	0,00%	SRB	0
	TRAKYA CAM	10.000	TRTRKCM91F7	TRKCM			10.000	4,52	29/12/2017				4,62		46,2	0,00%	0,00%	0,00%	SRB	0
	TRAKYA CAM	10.000	TRTRKCM91F7	TRKCM			10.000	4,52	29/12/2017				4,62		46,2	0,00%	0,00%	0,00%	SRB	0
	TRAKYA CAM	10.000	TRTRKCM91F7	TRKCM			10.000	4,52	29/12/2017				4,62		46,2	0,00%	0,00%	0,00%	SRB	0
	TRAKYA CAM	10.000	TRTRKCM91F7	TRKCM			10.000	4,52	29/12/2017				4,62		46,2	0,00%	0,00%	0,00%	SRB	0
	TRAKYA CAM	10.000	TRTRKCM91F7	TRKCM			10.000	4,52	29/12/2017				4,62		46,2	0,00%	0,00%	0,00%	SRB	0
	TRAKYA CAM	10.000	TRTRKCM91F7	TRKCM			10.000	4,52	29/12/2017				4,62		46,2	0,00%	0,00%	0,00%	SRB	0
	TRAKYA CAM	10.000	TRTRKCM91F7	TRKCM			10.000	4,52	29/12/2017				4,62		46,2	0,00%	0,00%	0,00%	SRB	0
	TRAKYA CAM	10.000	TRTRKCM91F7	TRKCM			10.000	4,52	29/12/2017				4,62		46,2	0,00%	0,00%	0,00%	SRB	0
	TRAKYA CAM	10.000	TRTRKCM91F7	TRKCM			10.000	4,52	29/12/2017				4,62		46,2	0,00%	0,00%	0,00%	SRB	0
	TRAKYA CAM	10.000	TRTRKCM91F7	TRKCM			10.000	4,52	29/12/2017				4,62		46,2	0,00%	0,00%	0,00%	SRB	0
	TRAKYA CAM	10.000	TRTRKCM91F7	TRKCM			10.000	4,52	29/12/2017				4,62		46,2	0,00%	0,00%	0,00%	SRB	0
	TRAKYA CAM	10.000	TRTRKCM91F7	TRKCM			10.000	4,52	29/12/2017				4,62		46,2	0,00%	0,00%	0,00%	SRB	0
	TRAKYA CAM	10.000	TRTRKCM91F7	TRKCM			10.000	4,52	29/12/2017				4,62		46,2	0,00%	0,00%	0,00%	SRB	0
	TRAKYA CAM	10.000	TRTRKCM91F7	TRKCM			10.000	4,52	29/12/2017				4,62		46,2	0,00%	0,00%	0,00%	SRB	0
	TRAKYA CAM	10.000	TRTRKCM91F7	TRKCM			10.000	4,52	29/12/2017				4,62		46,2	0,00%	0,00%	0,00%	SRB	0
	TRAKYA CAM	10.000	TRTRKCM91F7	TRKCM			10.000	4,52	29/12/2017				4,62		46,2	0,00%	0,00%	0,00%	SRB	0
	TRAKYA CAM	10.000	TRTRKCM91F7	TRKCM			10.000	4,52	29/12/2017				4,62		46,2	0,00%	0,00%	0,00%	SRB	0
	TRAKYA CAM	10.000	TRTRKCM91F7	TRKCM			10.000	4,52	29/12/2017				4,62		46,2	0,00%	0,00%	0,00%	SRB	0
	TRAKYA CAM	10.000	TRTRKCM91F7	TRKCM			10.000	4,52	29/12/2017				4,62		46,2	0,00%	0,00%	0,00%	SRB	0
	TRAKYA CAM	10.000	TRTRKCM91F7	TRKCM			10.000	4,52	29/12/2017				4,62		46,2	0,00%	0,00%	0,00%	SRB	0
	TRAKYA CAM	10.000	TRTRKCM91F7	TRKCM			10.000	4,52	29/12/2017				4,62		46,2	0,00%	0,00%	0,00%	SRB	0
	TRAKYA CAM	10.000	TRTRKCM91F7	TRKCM			10.000	4,52	29/12/2017				4,62		46,2	0,00%	0,00%	0,00%	SRB	0
	TRAKYA CAM	10.000	TRTRKCM91F7	TRKCM			10.000	4,52	29/12/2017				4,62		46,2	0,00%	0,00%	0,00%	SRB	0
	TRAKYA CAM	10.000	TRTRKCM91F7	TRKCM			10.000	4,52	29/12/2017				4,62		46,2	0,00%	0,00%	0,00%	SRB	0
	TRAKYA CAM	10.000	TRTRKCM91F7	TRKCM			10.000	4,52	29/12/2017				4,62		46,2	0,00%	0,00%	0,00%	SRB	0
	TRAKYA CAM	10.000	TRTRKCM91F7	TRKCM			10.000	4,52	29/12/2017				4,62		46,2	0,00%	0,00%	0,00%	SRB	0
	TRAKYA CAM	10.000	TRTRKCM91F7	TRKCM			10.000	4,52	29/12/2017				4,62		46,2	0,00%	0,00%	0,00%	SRB	0
	TRAKYA CAM	10.000	TRTRKCM91F7	TRKCM			10.000	4,52	29/12/2017				4,62		46,2	0,00%	0,00%	0,00%	SRB	0
	TRAKYA CAM	10.000	TRTRKCM91F7	TRKCM			10.000	4,52	29/12/2017				4,62		46,2	0,00%	0,00%	0,00%	SRB	0
	TRAKYA CAM	10.000	TRTRKCM91F7	TRKCM			10.000	4,52	29/12/2017				4,62		46,2	0,00%	0,00%	0,00%	SRB	0
	TRAKYA CAM	10.000	TRTRKCM91F7	TRKCM			10.000	4,52	29/12/2017				4,62		46,2	0,00%	0,00%	0,00%	SRB	0
	TRAKYA CAM	10.000	TRTRKCM91F7	TRKCM			10.000	4,52	29/12/2017				4,62		46,2	0,00%	0,00%	0,00%	SRB	0
	TRAKYA CAM	10.000	TRTRKCM91F7	TRKCM			10.000	4,52	29/12/2017				4,62		46,2	0,00%	0,00%	0,00%	SRB	0
	TRAKYA CAM	10.000	TRTRKCM91F7	TRKCM			10.000	4,52	29/12/2017				4,62		46,2	0,00%	0,00%	0,00%	SRB	0
	TRAKYA CAM	10.000	TRTRKCM91F7	TRKCM			10.000	4,52	29/12/2017				4,62		46,2	0,00%	0,00%	0,00%	SRB	0
	TRAKYA CAM	10.000	TRTRKCM91F7	TRKCM			10.000	4,52	29/12/2017				4,62		46,2	0,00%	0,00%	0,00%	SRB	0
	TRAKYA CAM	10.000	TRTRKCM91F7	TRKCM			10.000	4,52	29/12/2017				4,62		46,2	0,00%	0,00%	0,00%	SRB	0
	TRAKYA CAM	10.000	TRTRKCM91F7	TRKCM			10.000	4,52	29/12/2017				4,62		46,2	0,00%	0,00%	0,00%	SRB	0
	TRAKYA CAM	10.000	TRTRKCM91F7	TRKCM																

ALLIANZ YAŞAM VE EMEKLİLİK A.Ş.
KOÇ İŞTİRAK ENDEKSİ EMEKLİLİK YATIRIM FONU

31 ARALIK 2016 TARİHLİ TOPLAM FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU

(Tüm tutarlar, Türk Lirası ("TL") olarak gösterilmiştir.)

Menkul Kıymet	İhracı	Vade	ISIN Kodu	Menkul Tanım	Normal Faiz Oranı	Faiz Ode. Savv.	Nominal Deg./Kontrat Sayısı	Birim Alış Fiyatı	Satın Alış Tarihi	İç İskon. Oranı	Borsa Söze. No	Repo Teminat Tutarı	Günlük Birim Değer	Günlük Kur	Toplam Değer	Grup %	Toplam %	FTD %	DEP	VKG
A.PAY	ARCLK		TRAARCLK9IH5	ARCLK			1.145.000	16,317919	06.12.2016				21,2		24.274.000	8,59%	8,23%		SRB	0
	AYGAZ		TRAAAYGA29IE0	AYGAZ			2.580.000	10,477207	27.12.2016				12,03		31.037.400	10,98%	10,53%	10,51%	SRB	0
	FORD OTOSAN		TRAFOTOSN9IH6	FROTO			870.000	32,24161	02.12.2016				30,38		26.604.600	9,24%	9,03%	9,01%	SRB	0
	IS GMYO		TRAIISGY09IQ3	ISGYO			1.396484	09,022016					1,56		1	0,00%	0,00%	0,00%	SRB	0
	KOÇ HOLDING		TRAKCHOLDI9Q8	KCHOL			1.980.001	12,504033	28.11.2016				13,8		26.910.013	9,25%	9,13%	9,12%	SRB	0
	OTOKAR		TRAOTKAR9IH3	OTKAR			240.000	90,135077	04.11.2016				133,4		32.016.000	11,33%	10,86%	10,85%	SRB	0
	OTOKAR		TRAOTKAR9IH3	OTKAR			1	132,3	30.12.2016		SE4A228200333E73		133,4		133	0,00%	0,00%	0,00%	SRB	0
	OTOKAR		TRAOTKAR9IH3	OTKAR			2	132,3	30.12.2016		SE4A228200333E73		133,4		267	0,00%	0,00%	0,00%	SRB	0
	OTOKAR		TRAOTKAR9IH3	OTKAR			2	132,3	30.12.2016		SE4A228200333E73		133,4		267	0,00%	0,00%	0,00%	SRB	0
	OTOKAR		TRAOTKAR9IH3	OTKAR			2	132,4	30.12.2016		SE4A228200333A9D0		133,4		267	0,00%	0,00%	0,00%	SRB	0
	OTOKAR		TRAOTKAR9IH3	OTKAR			2	132,6	30.12.2016		SE4A228200333AABC		133,4		267	0,00%	0,00%	0,00%	SRB	0
	OTOKAR		TRAOTKAR9IH3	OTKAR			2	132,6	30.12.2016		SE4A228200333AABC		133,4		267	0,00%	0,00%	0,00%	SRB	0
	OTOKAR		TRAOTKAR9IH3	OTKAR			2	132,3	30.12.2016		SE4A228200333E73		133,4		534	0,00%	0,00%	0,00%	SRB	0
	OTOKAR		TRAOTKAR9IH3	OTKAR			2	132,3	30.12.2016		SE4A228200333E73		133,4		667	0,00%	0,00%	0,00%	SRB	0
	OTOKAR		TRAOTKAR9IH3	OTKAR			2	132,3	30.12.2016		SE4A228200333E73		133,4		667	0,00%	0,00%	0,00%	SRB	0
	OTOKAR		TRAOTKAR9IH3	OTKAR			2	132,4	30.12.2016		SE4A228200333A9D0		133,4		800	0,00%	0,00%	0,00%	SRB	0
	OTOKAR		TRAOTKAR9IH3	OTKAR			2	132,6	30.12.2016		SE4A228200333AABC		133,4		800	0,00%	0,00%	0,00%	SRB	0
	OTOKAR		TRAOTKAR9IH3	OTKAR			101	132,9	30.12.2016		SE4A228200333E73		133,4		1.334	0,00%	0,00%	0,00%	SRB	0
	OTOKAR		TRAOTKAR9IH3	OTKAR			101	133	30.12.2016		SE4A228200333E73		133,4		1.334	0,00%	0,00%	0,00%	SRB	0
	OTOKAR		TRAOTKAR9IH3	OTKAR			11	132,2	30.12.2016		SE4A2282003313F2		133,4		1.467	0,00%	0,00%	0,00%	SRB	0
	OTOKAR		TRAOTKAR9IH3	OTKAR			11	132,9	30.12.2016		SE4A228200333E73		133,4		1.467	0,00%	0,00%	0,00%	SRB	0
	OTOKAR		TRAOTKAR9IH3	OTKAR			11	132,6	30.12.2016		SE4A228200333AABC		133,4		1.467	0,00%	0,00%	0,00%	SRB	0
	OTOKAR		TRAOTKAR9IH3	OTKAR			15	133	30.12.2016		SE4A228200333E73		133,4		2.001	0,00%	0,00%	0,00%	SRB	0
	OTOKAR		TRAOTKAR9IH3	OTKAR			16	132,4	30.12.2016		SE4A228200333A9D0		133,4		2.134	0,00%	0,00%	0,00%	SRB	0
	OTOKAR		TRAOTKAR9IH3	OTKAR			17	132,4	30.12.2016		SE4A228200333A9D0		133,4		2.268	0,00%	0,00%	0,00%	SRB	0
	OTOKAR		TRAOTKAR9IH3	OTKAR			18	132,8	30.12.2016		SE4A228200333AABC		133,4		2.401	0,00%	0,00%	0,00%	SRB	0
	OTOKAR		TRAOTKAR9IH3	OTKAR			20	132,5	30.12.2016		SE4A228200333AABC		133,4		2.668	0,00%	0,00%	0,00%	SRB	0
	OTOKAR		TRAOTKAR9IH3	OTKAR			21	132	30.12.2016		SE4A228200333E73		133,4		2.801	0,00%	0,00%	0,00%	SRB	0
	OTOKAR		TRAOTKAR9IH3	OTKAR			21	132	30.12.2016		SE4A228200333E73		133,4		2.801	0,00%	0,00%	0,00%	SRB	0
	OTOKAR		TRAOTKAR9IH3	OTKAR			22	132,2	30.12.2016		SE4A228200333E73		133,4		3.035	0,00%	0,00%	0,00%	SRB	0
	OTOKAR		TRAOTKAR9IH3	OTKAR			23	132,4	30.12.2016		SE4A228200333A9D0		133,4		3.068	0,00%	0,00%	0,00%	SRB	0
	OTOKAR		TRAOTKAR9IH3	OTKAR			24	132,4	30.12.2016		SE4A228200333A9D0		133,4		3.202	0,00%	0,00%	0,00%	SRB	0
	OTOKAR		TRAOTKAR9IH3	OTKAR			25	132	30.12.2016		SE4A228200333E73		133,4		3.335	0,00%	0,00%	0,00%	SRB	0
	OTOKAR		TRAOTKAR9IH3	OTKAR			100	132,4	30.12.2016		SE4A228200333E73		133,4		13.340	0,00%	0,00%	0,00%	SRB	0
	OTOKAR		TRAOTKAR9IH3	OTKAR			135	132,6	30.12.2016		SE4A228200333E73		133,4		18.009	0,01%	0,01%	0,01%	SRB	0
	OTOKAR		TRAOTKAR9IH3	OTKAR			150	132,9	30.12.2016		SE4A228200333AABC		133,4		20.010	0,01%	0,01%	0,01%	SRB	0
	OTOKAR		TRAOTKAR9IH3	OTKAR			150	132,2	30.12.2016		SE4A228200333E73		133,4		20.010	0,01%	0,01%	0,01%	SRB	0
	OTOKAR		TRAOTKAR9IH3	OTKAR			200	132,2	30.12.2016		SE4A2282003313F2		133,4		26.680	0,01%	0,01%	0,01%	SRB	0
	OTOKAR		TRAOTKAR9IH3	OTKAR			200	133	30.12.2016		SE4A228200333E73		133,4		26.680	0,01%	0,01%	0,01%	SRB	0
	OTOKAR		TRAOTKAR9IH3	OTKAR			200	132,3	30.12.2016		SE4A228200333E73		133,4		26.680	0,01%	0,01%	0,01%	SRB	0
	OTOKAR		TRAOTKAR9IH3	OTKAR			200	132,8	30.12.2016		SE4A228200333AABC		133,4		26.680	0,01%	0,01%	0,01%	SRB	0
	OTOKAR		TRAOTKAR9IH3	OTKAR			253	132,3	30.12.2016		SE4A228200333E73		133,4		31.082	0,01%	0,01%	0,01%	SRB	0
	OTOKAR		TRAOTKAR9IH3	OTKAR			260	132,9	30.12.2016		SE4A228200333E73		133,4		33.350	0,01%	0,01%	0,01%	SRB	0
	OTOKAR		TRAOTKAR9IH3	OTKAR			300	132,4	30.12.2016		SE4A228200333E73		133,4		40.020	0,01%	0,01%	0,01%	SRB	0
	OTOKAR		TRAOTKAR9IH3	OTKAR			300	132	30.12.2016		SE4A228200333E73		133,4		40.220	0,01%	0,01%	0,01%	SRB	0
	OTOKAR		TRAOTKAR9IH3	OTKAR			396	132,3	30.12.2016		SE4A228200333E73		133,4		52.826	0,02%	0,02%	0,02%	SRB	0
	OTOKAR		TRAOTKAR9IH3	OTKAR			500	132,2	30.12.2016		SE4A2282003313F2		133,4		66.700	0,02%	0,02%	0,02%	SRB	0
	OTOKAR		TRAOTKAR9IH3	OTKAR			600	132,9	30.12.2016		SE4A228200333E73		133,4		80.040	0,03%	0,03%	0,03%	SRB	0
	OTOKAR		TRAOTKAR9IH3	OTKAR			656	133	30.12.2016		SE4A228200333E73		133,4		87.510	0,03%	0,03%	0,03%	SRB	0
	OTOKAR		TRAOTKAR9IH3	OTKAR			780	132,4	30.12.2016		SE4A228200333A9D0		133,4		104.052	0,04%	0,04%	0,04%	SRB	0
	OTOKAR		TRAOTKAR9IH3	OTKAR			1.078	132,9	30.12.2016		SE4A228200333AABC		133,4		143.805	0,05%	0,05%	0,05%	SRB	0
	OTOKAR		TRAOTKAR9IH3	OTKAR			25	132,8	30.12.2016		SE4A228200333AABC		133,4		3.335	0,00%	0,00%	0,00%	SRB	0
	OTOKAR		TRAOTKAR9IH3	OTKAR			25	132,9	30.12.2016		SE4A228200333E73		133,4		3.335	0,00%	0,00%	0,00%	SRB	0
	OTOKAR		TRAOTKAR9IH3	OTKAR			33	133	30.12.2016		SE4A228200333E73		133,4		4.402	0,00%	0,00%	0,00%	SRB	0
	OTOKAR		TRAOTKAR9IH3	OTKAR			37	132,4	30.12.2016		SE4A228200333A9D0		133,4		4.936	0,00%	0,00%	0,00%	SRB	0
	OTOKAR		TRAOTKAR9IH3	OTKAR			41	132,3	30.12.2016		SE4A228200333E73		133,4		5.469	0,00%	0,00%	0,00%	SRB	0
	OTOKAR		TRAOTKAR9IH3	OTKAR			44	132,4	30.12.2016		SE4A228200333E73		133,4		5.570	0,00%	0,00%	0,00%	SRB	0
	OTOKAR		TRAOTKAR9IH3	OTKAR			49	132,2	30.12.2016		SE4A2282003313F2		133,4		6.537	0,00%	0,00%	0,00%	SRB	0
	OTOKAR		TRAOTKAR9IH3	OTKAR			65	133	30.12.2016		SE4A228200333E73		133,4		8.404	0,00%	0,00%	0,00%	SRB	0
	OTOKAR		TRAOTKAR9IH3	OTKAR			68	132,2	30.12.2016		SE4A2282003313F2		133,4		9.071	0,00%	0,00%	0,00%	SRB	0
	OTOKAR		TRAOTKAR9IH3	OTKAR			88	132,7	30.12.2016		SE4A228200333AABC		133,4		11.739	0,00%	0,00%	0,0		

ALLIANZ YAŞAM VE EMEKLİLİK A.Ş.
KOÇ İŞTİRAK ENDEKSİ EMEKLİLİK YATIRIM FONU

31 ARALIK 2016 TARİHLİ TOPLAM FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU

(Tüm tutarlar, Türk Lirası ("TL") olarak gösterilmiştir.)

Menkul Kıymet	İhraççı	Vade	ISIN Kodu	Menkul Tanım	Normal Faiz Oranı	Faiz Öde. Savı.	Nominal Deg./Kontrat Sayısı	Birim Alış Fiyatı	Satın Alış Tarihi	İç İskon. Oranı	Borsa Sözle. No	Repo Teminat Tutarı	Günlük Birim Değer	Günlük Kur	Toplam Değer	Grup %	Toplam %	FTD %	DEP	VKG
OTOKAR			TRAOTKAR91H3	OTKAR			100	132,7	30.12.2016		5E4A228200399196		133,4		13.340	0,00%	0,00%	0,00%	SRB	0
OTOKAR			TRAOTKAR91H3	OTKAR			100	132,8	30.12.2016		5E4A22820033AAABC		133,4		13.340	0,00%	0,00%	0,00%	SRB	0
OTOKAR			TRAOTKAR91H3	OTKAR			100	132,8	30.12.2016		5E4A228200399196		133,4		13.340	0,00%	0,00%	0,00%	SRB	0
OTOKAR			TRAOTKAR91H3	OTKAR			100	132,9	30.12.2016		5E4A22820033AAABC		133,4		13.340	0,00%	0,00%	0,00%	SRB	0
OTOKAR			TRAOTKAR91H3	OTKAR			100	132,9	30.12.2016		5E4A22820033AAABC		133,4		13.340	0,00%	0,00%	0,00%	SRB	0
OTOKAR			TRAOTKAR91H3	OTKAR			100	132,8	30.12.2016		5E4A22820033AAABC		133,4		13.340	0,00%	0,00%	0,00%	SRB	0
OTOKAR			TRAOTKAR91H3	OTKAR			100	132,8	30.12.2016		5E4A22820033AAABC		133,4		13.340	0,00%	0,00%	0,00%	SRB	0
OTOKAR			TRAOTKAR91H3	OTKAR			100	132,8	30.12.2016		5E4A22820033AAABC		133,4		13.340	0,00%	0,00%	0,00%	SRB	0
OTOKAR			TRAOTKAR91H3	OTKAR			100	132,5	30.12.2016		5E4A228200399196		133,4		13.340	0,00%	0,00%	0,00%	SRB	0
OTOKAR			TRAOTKAR91H3	OTKAR			100	132,6	30.12.2016		5E4A22820033AAABC		133,4		13.340	0,00%	0,00%	0,00%	SRB	0
OTOKAR			TRAOTKAR91H3	OTKAR			100	132,6	30.12.2016		5E4A22820033AAABC		133,4		13.340	0,00%	0,00%	0,00%	SRB	0
Ara Toplam															33.216.600	11,75%	11,27%	11,25%	SRB	0
	TAT GIDA		TRAOTKAR91H3	OTKAR			249.000		28.12.2016				5,73		24.581.700	8,70%	8,34%	8,33%	SRB	0
	TAT GIDA		TRATATKS91A5	TATGD			5.172.969		28.12.2016				8,70		45.000	0,16%	0,16%	0,16%	SRB	0
	TOFAŞ OTO. FAB.		TRATOASO91H3	TOASO			1.250.000	19.002017	27.09.2016				24,64		30.800.000	10,90%	10,45%	10,43%	SRB	0
	TURK TRAKTOR		TRTTRK00010	TTRAK			370.000	74.487075	20.12.2016				75		27.750.000	9,82%	9,41%	9,40%	SRB	0
	TUPRAS		TRATUPRS91E8	TUPRS			412.500	66.076323	25.11.2016				70,75		29.184.379	10,33%	9,90%	9,89%	SRB	0
	Yapı ve Kredi Bankası		TRAYKBNK91N6	YKBNK			8.250.000	3.721661	15.12.2016				5,43		28.297.500	10,01%	9,60%	9,59%	SRB	0
Toplam															282.656.190		95,89%	95,75%		
GRUP TOPLAMI															282.656.190		95,89%	95,75%		
G.DİĞER																				
VARLIKLAR																				
TERS REPO - DT		02.01.2017	TRT111120T18	TRT111120T18	8,41%		4.503.111	89.441172	30.12.2016	8,77%		5.031.240	89.482383	1	4.502.073	37,13%	1,53%	1,53%	SRB	3
		02.01.2017	TRT240724T15	TRT240724T15	8,41%		6.004.147	89.969793	30.12.2016	8,77%		6.668.905	90.011248	1	6.002.765	49,50%	2,04%	2,03%	SRB	3
		02.01.2017	TRT240724T15	TRT240724T15	8,41%		1.501.037	89.96959	30.12.2016	8,77%		1.667.230	90.011043	1	1.500.691	12,38%	0,51%	0,51%	SRB	3
Ara Toplam															7.503.184	61,88%	2,55%	2,54%		
Toplam															12.008.295		4,07%	4,07%		
BPP		02.01.2017			9,55%	0,000	120.094	100.000,00	30.12.2016	10,01%			100,052,33	1	120,063	0,99%	0,04%	0,04%	SRB	3
Toplam															120,063		0,04%	0,04%		
GRUP TOPLAMI															12.128.389		4,11%	4,11%		
FONORTAKLIK PORTFÖY DEĞERİ															13.367,375					
															13.367,375					
															294.781.782					

ALLIANZ YAŞAM VE EMEKLİLİK A.Ş.
KOÇ İŞTİRAK ENDEKSİ EMEKLİLİK YATIRIM FONU

31 ARALIK 2017 TARİHLİ TOPLAM DEĞER/NET VARLIK DEĞERİ TABLOSU
(Tüm tutarlar, Türk Lirası (“TL”) olarak gösterilmiştir.)

	31 Aralık 2017			31 Aralık 2016		
	Tutar TL	Grup %	Toplam %	Tutar TL	Grup %	Toplam %
A. FON PORTFÖY DEĞERİ (MİZANDAN PORTFÖY DEĞERİ)	398.193.894	-	100,27%	297.023.965	-	100,62%
B. HAZIR DEĞERLER	1.788	100,00%	-	1.021	100,00%	-
a) Kasa	-	-	-	-	-	-
b) Bankalar	1.788	100,00%	-	1.021	100,00%	-
c) Diğer Hazır Değerler	-	-	-	-	-	-
C. ALACAKLAR	7.236.913	100,00%	1,82%	195.301	100,00%	0,07%
a) Takastan Alacaklar T1	6.121.250	84,58%	1,54%	-	-	-
b) Takastan Alacaklar T2	735.750	10,17%	0,19%	-	-	-
c) Takastan BPP Alacakları	-	-	-	-	-	-
d) Diğer Alacaklar	379.913	5,25%	0,1%	195.301	100,00%	0,07%
D. DİĞER VARLIKLAR	-	-	-	-	-	-
E. BORÇLAR	8.298.407	(100,00)%	(2,09)%	2.015.931	(100,00)%	(0,68)%
a) Takasa Borçlar T1	5.230.523	(63,03)%	(1,32)%	-	-	-
b) Takasa Borçlar T2	2.335.017	(28,14)%	(0,59)%	1.195.272	(59,30)%	(0,40)%
c) Yönetim Ücreti	604.005	(7,28)%	(0,15)%	451.658	(22,40)%	(0,15)%
d) Ödenecek Vergi	-	-	-	-	-	-
e) İhtiyatlar	-	-	-	-	-	-
f) Krediler	-	-	-	-	-	-
g) Diğer Borçlar	128.862	(1,55)%	(0,03)%	369.001	(18,30)%	(0,13)%
Fon toplam değeri	397.134.187		100,00	295.204.356		100,00

31 Aralık 2017 ve 1 Ocak 2018 tarihlerinin tatil günü olması sebebi ile Fon'un cari dönem sonu itibariyle hazırlanan Performans Sunuş Raporu'nda birim pay değeri hesaplamasında 2 Ocak 2018 tarihinde geçerli olan Fon Toplam Değeri kullanılmıştır.

.....